

# 瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:瑞达基金管理有限公司

基金托管人:招商证券股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	52
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	53
§9 开放式基金份额变动 .....	53
§10 重大事件揭示 .....	53
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
§12 备查文件目录 .....	56
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金	
基金简称	瑞达策略优选混合发起	
基金主代码	015694	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年05月17日	
基金管理人	瑞达基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,079,162.65份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	瑞达策略优选混合发起A	瑞达策略优选混合发起C
下属分级基金的交易代码	015694	015695
报告期末下属分级基金的份额总额	10,020,640.82份	58,521.83份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略，通过对宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、市场走势以及市场流动性等进行综合分析，并结合回撤与风险管理要求，积极动态调整权益资产仓位。采用定量和定性相结合的方法进行资产配置，在严格控制风险的前提下，定期对投资组合类属资产进行优化，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		瑞达基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡因	韩鑫普
	联系电话	021-53308822	0755-82943666
	电子邮箱	kf@ruidaamc.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4009958822	95565
传真		021-53391131	0755-82960794
注册地址		厦门市思明区槟榔西里197号 第一层448室	深圳市福田区福田街道福华 一路111号
办公地址		上海市浦东新区福山路500号 城建国际中心2508-2510	深圳市福田区福田街道福华 一路111号
邮政编码		200122	518000
法定代表人		徐志谋	霍达

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ruidaamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	瑞达基金管理有限公司	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心2508-2510

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	瑞达策略优选混合 发起A	瑞达策略优选混合 发起C
本期已实现收益	-1,270,036.24	-1,121.29
本期利润	31,551.11	1,343.75
加权平均基金份额本期利润	0.0031	0.0955
本期加权平均净值利润率	0.37%	11.15%
本期基金份额净值增长率	0.40%	2.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-2,541,821.58	-13,286.80
期末可供分配基金份额利润	-0.2537	-0.2270
期末基金资产净值	8,495,900.48	51,263.67
期末基金份额净值	0.8478	0.8760
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-15.22%	-12.40%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

瑞达策略优选混合发起A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	13.15%	1.29%	0.61%	0.69%	12.54%	0.60%

过去三个月	0.46%	1.31%	-3.89%	0.64%	4.35%	0.67%
过去六个月	0.40%	1.21%	0.50%	0.64%	-0.10%	0.57%
过去一年	-16.86%	1.40%	-9.38%	0.76%	-7.48%	0.64%
自基金合同生效起至今	-15.22%	1.34%	-0.02%	0.78%	-15.20%	0.56%

瑞达策略优选混合发起C

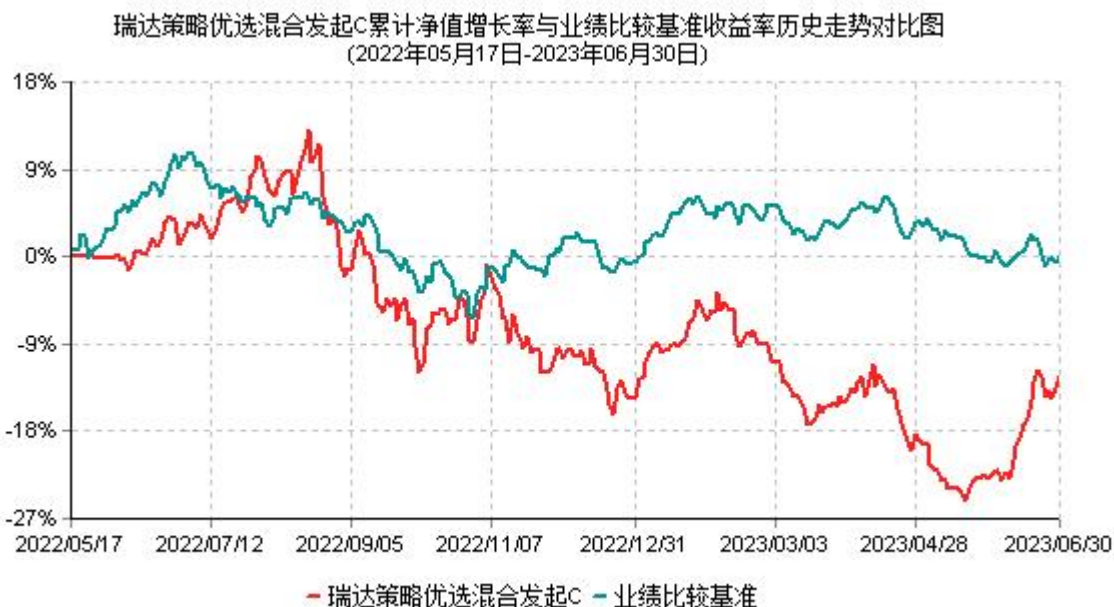
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	13.49%	1.29%	0.61%	0.69%	12.88%	0.60%
过去三个月	2.61%	1.34%	-3.89%	0.64%	6.50%	0.70%
过去六个月	2.66%	1.22%	0.50%	0.64%	2.16%	0.58%
过去一年	-14.07%	1.40%	-9.38%	0.76%	-4.69%	0.64%
自基金合同生效起至今	-12.40%	1.34%	-0.02%	0.78%	-12.38%	0.56%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

瑞达策略优选混合发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年05月17日-2023年06月30日)







注：本基金合同生效日为2022年05月17日。根据基金合同约定，本基金建仓期为6个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

瑞达基金管理有限公司是经中国证监会批准成立的全国性基金管理公司。公司成立于2020年3月，注册资本为1.7亿元人民币，为瑞达期货股份有限公司（002961.SZ）100%控股子公司。获准经营的业务包括公开募集证券投资基金管理、基金销售。截至2023年6月30日，公司旗下管理4只证券投资基金——瑞达行业轮动混合型证券投资基金、瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金、瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金和瑞达先进制造混合型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

袁忠伟	本基金的基金经理	2022-05-17	-	22	<p>国籍：中国。学历：北京工业大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任苏州非金属矿工业设计研究院助理工程师、中国民族证券有限责任公司证券投资部总经理助理、华西证券股份有限公司资产管理部研究总监、英大基金管理有限公司权益投资部总经理、郑州明泉基金管理有限公司投资研究部投资总监、副总经理。2021年1月4日加入瑞达基金管理有限公司投资研究部担任投资总监。2021年6月9日至今任瑞达行业轮动混合型证券投资基金的基金经理。2021年7月14日至今任瑞达鑫红量化6个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022年5月17日至今任瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金的基金经理。</p>
杜宇	本基金的基金经理	2022-11-02	-	5	<p>国籍：中国。学历：复旦大学数学科学学院金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任利安人寿保险股份有限公司权益研究岗、利安人寿保险股份有限公司权益投资岗。2022年1月10日加入瑞达基金管理有限公</p>

					司投资研究部担任基金经理助理。2022年11月2日至今任瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金的基金经理。2023年4月14日至今任瑞达先进制造混合型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部关于公平交易流程的各项制度规范。本公司通过系统控制和人工控制等各种方式，确保本公司管理的所有投资组合在研究分析、投资决策、交易执行、授权、业绩评估等投资管理活动各个环节均得到公平对待。本报告期内，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人严格执行公司异常交易监控与报告相关制度，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，基金管理人管理

的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均未出现超过该证券当日交易量的5%的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年一季度仓位中枢保持在85%左右，组合行业配置有一定变化。产品净值在市场极致轮动中经历了比较大波动，1月到2月中旬受益于新能源行业年后开工修复，产品净值有所反弹；2月中旬开始，市场对于新能源基本面的担心开始发酵，导致组合在泛新能源上如汽车、光伏、风电、储能等主力仓位上经历了一轮回撤，影响了产品净值。本轮AI行情带有明显主题投资色彩，但对产业界的影响也明显可见，因此，产品组合在考虑公司产业竞争力、基本面业绩、估值、风险点等基本面因素后，增加了部分TMT方向持仓。

二季度组合仓位中枢有所下移，保持在75%左右，组合行业配置在科技成长细分方向上更加均衡，组合净值在季度内虽然经历波动但也保持了稳定。具体来看，新能源行业，光伏硅料价格持续下跌，驱动产业链降价，光伏装机同比保持较高增速，组合配置方向主要在TOPCon电池、部分辅材环节；风电上半年装机低于预期，储能招投标放缓，竞争比较激烈，因此在这两个方向上做了减配；新能源整车厂价格战有所减退，5、6月销量环比改善，组合增配了新能源车零部件。人工智能在ChatGPT的推动下，快速发展为产业趋势，国内厂商也陆续推出大模型，赋能垂类应用降本增效。AI算力和应用预计将成为两大确定性投入的环节，组合在相关标的上也做了配置。此外，机器人作为AI应用的终极载体，其长期确定性很大程度上受到市场认可，组合精选了部分主业有支撑且掌握核心机器人零部件供应能力的标的作为持仓。市场风格变换，在投资运作过程中，本基金灵活运用多种投资策略，保持建仓和调仓原则的一致性，根据宏观和中观行业比较，优选行业配置方向，同时结合自下而上分析优选个股，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末瑞达策略优选混合发起A基金份额净值为0.8478元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.40%，同期业绩比较基准收益率为0.50%；截至报告期末瑞达策略优选混合发起C基金份额净值为0.8760元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.66%，同期业绩比较基准收益率为0.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年二季度经济修复力度低于预期，供给端去库压制生产，房地产投资同比增速继续回落，居民端表现不佳，5月社融低于预期，消费修复缓慢，出口也进一步下探。

国内经济经历了疫后修复红利期，需求有所转弱。但是6月开始，宏观经济部分指标大部分呈现好转迹象，比如6月PMI细分数据显示，原材料价格和出厂价格两大价格指数在连续三个月的下降后迎来回升，产成品库存大幅降低，表明去库进程加快，价格和库存触底很大程度上是经济企稳的信号。展望三季度，预计经济在稳增长政策带动下，环比或将开始修复，三季度末有望迎来企业盈利底部，四季度或开启补库。

证券市场方面，4月的市场总体震荡往下，AI+中特估成为市场主线，但AI或已经步入炒作后期，表现为传媒领涨。传媒在产业链上处于TMT的应用端，传媒领涨反映AI炒作可能步入阶段性尾声。5月市场普跌，几乎所有宽基指数涨跌幅均为负，反映了市场对国内宏观经济走弱的担心。6月市场波动加大，上半月上涨下半月下跌，稳增长政策预期升温带来经济悲观预期的部分修正，但弱现实的经济环境下，市场反弹不多，股价运行仍偏弱。往后看，当前股权风险溢价已经处于历史偏高位置，预计市场向下空间有限，随着三季度经济好转，配置或将转向积极。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,662,125.52	2,135,713.42
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	6,903,757.98	6,524,239.60
其中：股票投资		6,903,757.98	6,524,239.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		20.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		8,565,903.50	8,659,953.02
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		75.63	-
应付管理人报酬		9,901.79	11,195.52
应付托管费		1,320.24	1,492.73
应付销售服务费		2.59	1.83
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	7,439.10	155,000.00
负债合计		18,739.35	167,690.08
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.7	10,079,162.65	10,056,995.90
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-1,531,998.50	-1,564,732.96
净资产合计		8,547,164.15	8,492,262.94
负债和净资产总计		8,565,903.50	8,659,953.02

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额总额10,079,162.65份，其中瑞达策略优选混合发起A类基金份额总额为10,020,640.82份，基金份额净值0.8478元；瑞达策略优选混合发起C类基金份额总额58,521.83份，基金份额净值0.8760元。

## 6.2 利润表

会计主体：瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年05月17日（基金 合同生效日）至2022 年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		111,707.33	248,754.73
1.利息收入		2,362.20	11,362.23
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,362.20	7,845.70
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	3,516.53
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-1,195,080.35	-19,673.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,218,314.20	-23,712.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-



资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	23,233.85	4,038.52
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
<b>3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）</b>	6.4.7.16	1,304,052.39	257,066.06
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	373.09	-
<b>减：二、营业总支出</b>		78,812.47	51,545.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	62,966.06	18,251.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,395.46	2,433.45
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	11.85	2.64
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	7,439.10	30,858.25
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		32,894.86	197,209.30
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		32,894.86	197,209.30
<b>五、其他综合收益的税后</b>		-	-

净额			
六、综合收益总额		32,894.86	197,209.30

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	10,056,995.90	-	-1,564,732.96	8,492,262.94
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	10,056,995.90	-	-1,564,732.96	8,492,262.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	22,166.75	-	32,734.46	54,901.21
（一）、综合收益总额	-	-	32,894.86	32,894.86
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	22,166.75	-	-160.40	22,006.35
其中：1.基金申	123,226.71	-	-17,997.82	105,228.89

购款				
2.基金赎回款	-101,059.96	-	17,837.42	-83,222.54
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	10,079,162.65	-	-1,531,998.50	8,547,164.15
项目	上年度可比期间 2022年05月17日(基金合同生效日)至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	10,021,168.84	-	-	10,021,168.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	197,209.30	197,209.30
(一)、综合收	-	-	197,209.30	197,209.30

益总额				
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中: 1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	10,021,168.84	-	197,209.30	10,218,378.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

蔡炎坤

刘冬

王俊晔

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人瑞达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,

经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2022]768号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为10,021,168.84份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(22)第00222号的验资报告。基金合同于2022年5月17日正式生效。本基金的基金管理人为瑞达基金管理有限公司,基金托管人为招商证券股份有限公司。根据基金合同相关规定,本基金份额分为A类基金份额(以下简称“瑞达策略优选混合发起A”)和C类基金份额(以下简称“瑞达策略优选混合发起C”)两类份额。其中,瑞达策略优选混合发起A是指在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;瑞达策略优选混合发起C是指在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具(含同业存单)、银行存款(包括定期存款、协议存款及其他银行存款)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票及存托凭证的比例为基金资产的60%-95%,每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2023年06月30日的财务状况以及自2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	84,372.51
等于：本金	84,314.37
加：应计利息	58.14
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	1,577,753.01
等于：本金	1,577,633.53
加：应计利息	119.48
减：坏账准备	-

合计	1,662,125.52
----	--------------

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,886,533.70	-	6,903,757.98	1,017,224.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,886,533.70	-	6,903,757.98	1,017,224.28

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产



**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

其他资产期末无余额。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	7,439.10
合计	7,439.10

**6.4.7.7 实收基金****6.4.7.7.1 瑞达策略优选混合发起A**

金额单位：人民币元

项目 (瑞达策略优选混合发起A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,046,964.64	10,046,964.64
本期申购	18,130.91	18,130.91
本期赎回（以“-”号填列）	-44,454.73	-44,454.73
本期末	10,020,640.82	10,020,640.82

**6.4.7.7.2 瑞达策略优选混合发起C**

金额单位：人民币元

项目 (瑞达策略优选混合发起C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	10,031.26	10,031.26
本期申购	105,095.80	105,095.80
本期赎回(以“-”号填列)	-56,605.23	-56,605.23
本期末	58,521.83	58,521.83

本期申购含红利再投、转换入份(金)额,本期赎回含转换出份(金)额。

### 6.4.7.8 未分配利润

#### 6.4.7.8.1 瑞达策略优选混合发起A

单位:人民币元

项目 (瑞达策略优选混合发起A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,278,889.81	-284,371.21	-1,563,261.02
本期利润	-1,270,036.24	1,301,587.35	31,551.11
本期基金份额交易产生的变动数	7,104.47	-134.90	6,969.57
其中:基金申购款	-3,556.60	665.72	-2,890.88
基金赎回款	10,661.07	-800.62	9,860.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,541,821.58	1,017,081.24	-1,524,740.34

#### 6.4.7.8.2 瑞达策略优选混合发起C

单位:人民币元

项目 (瑞达策略优选混合发起C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,177.96	-293.98	-1,471.94
本期利润	-1,121.29	2,465.04	1,343.75
本期基金份额交易产	-10,987.55	3,857.58	-7,129.97

生的变动数			
其中：基金申购款	-21,692.23	6,585.29	-15,106.94
基金赎回款	10,704.68	-2,727.71	7,976.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,286.80	6,028.64	-7,258.16

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	329.26
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,032.94
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	2,362.20

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	32,502,455.96
减：卖出股票成本总额	33,655,352.41
减：交易费用	65,417.75
买卖股票差价收入	-1,218,314.20

#### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	23,233.85
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,233.85

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	1,304,052.39
——股票投资	1,304,052.39
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,304,052.39

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	373.09
合计	373.09

**6.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	7,439.10
信息披露费	-
证券出借违约金	-
合计	7,439.10

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

本基金于2023年7月27日发布公告，自2023年7月28日起，下调本基金的基金管理费率至1.2%/年，同时，相应修订《瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金基金合同》和《瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金托管协议》的相关条款。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
瑞达基金管理有限公司(“瑞达基金”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年05月17日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
招商证券	65,233,274.36	100.00%	4,574,205.14	100.00%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年05月17日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
招商证券	-	-	7,900,000.00	100.00%

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	27,780.08	10 0.0 0%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	3,381.39	10 0.0 0%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。基金托管人招商证券受托作为本基金的证券经纪商，为本基金证券交易提供支持服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年05月17日（基金合同 生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	62,966.06	18,251.09
其中：支付销售机构的客户维护费	113.64	1.76

注：支付基金管理人瑞达基金的基金管理费按前一日基金资产净值×1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年05月17日（基金合同生 效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,395.46	2,433.45

注：支付基金托管人招商证券的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产×0.20%÷当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费



名称	瑞达策略优选混合发起A	瑞达策略优选混合发起C	合计
瑞达基金	0.00	8.67	8.67
合计	0.00	8.67	8.67
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2022年05月17日（基金合同生效日）至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	瑞达策略优选混合发起A	瑞达策略优选混合发起C	合计
瑞达基金	0.00	2.64	2.64
合计	0.00	2.64	2.64

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按基金前一日基金资产净值×0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：瑞达策略优选混合发起C的日销售服务费=前一日瑞达策略优选混合发起C基金资产净值×0.20%÷当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

瑞达策略优选混合发起A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01	上年度可比期间 2022年05月17日（基金

	日至2023年06 月30日	合同生效日)至2022年0 6月30日
基金合同生效日（2022年05月17日）持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	99.79%	99.53%

瑞达策略优选混合发起C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01 日至2023年06 月30日	上年度可比期间 2022年05月17日（基金 合同生效日）至2022年0 6月30日
基金合同生效日（2022年05月17日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：（1）报告期末持有的基金份额占基金总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；（2）本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年05月17日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券	84,372.51	329.26	9,989.68	6,521.77

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有临时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

**6.4.13 金融工具风险及管理**

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人以保护投资者利益为核心，将内部控制和风险管理有机地结合起来，注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创造良好的内部控制环境。本基金管理人建立起包括公司内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章和业务指引、细则、规范等四个层次的规章制度体系，建立了一套进行风险识别、评估、控制和报告的机制、制度和措施，围绕总体经营战略建立起覆盖公司投资、研究、销售和运营等业务流程的全面的风险管理体系，以完善的内部控制程序和控制措施，有效保障稳健经营和长期发展。

本基金管理人建立了多层次的内部控制与风控体系，主要包括：(1) 董事会领导下的合规审计委员会的控制和指导；(2) 督察长领导下的监察稽核部风险控制岗的检查、监督；(3) 部门主管的检查监督；(4) 员工自律。

公司监察稽核部设立风险控制岗，专门负责投资管理风险控制监督工作，适时出具监督意见或风险建议；对于风险控制相关法律法规、规章制度、风险控制委员会决议的落实情况进行监督；对于投资关联交易以及其它风险相关事项进行检查监督。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,662,125.52	-	-	-	1,662,125.52
交易性 金融资产	-	-	-	6,903,757.98	6,903,757.98
应收申 购款	-	-	-	20.00	20.00
资产总 计	1,662,125.52	-	-	6,903,777.98	8,565,903.50
负债					
应付赎 回款	-	-	-	75.63	75.63
应付管 理人报 酬	-	-	-	9,901.79	9,901.79
应付托 管费	-	-	-	1,320.24	1,320.24
应付销 售服务 费	-	-	-	2.59	2.59
其他负 债	-	-	-	7,439.10	7,439.10
负债总 计	-	-	-	18,739.35	18,739.35
利率敏 感度缺 口	1,662,125.52	-	-	6,885,038.63	8,547,164.15
上年度 末 2022年1 2月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,135,713.42	-	-	-	2,135,713.42

交易性金融资产	-	-	-	6,524,239.60	6,524,239.60
资产总计	2,135,713.42	-	-	6,524,239.60	8,659,953.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	11,195.52	11,195.52
应付托管费	-	-	-	1,492.73	1,492.73
应付销售服务费	-	-	-	1.83	1.83
其他负债	-	-	-	155,000.00	155,000.00
负债总计	-	-	-	167,690.08	167,690.08
利率敏感度缺口	2,135,713.42	-	-	6,356,549.52	8,492,262.94

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年06月30日，本基金未持有的交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	6,903,757.98	80.77	6,524,239.60	76.83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,903,757.98	80.77	6,524,239.60	76.83

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1.中证800指数收益率上升5%	339,524.85	362,905.54
	2.中证800指数收益率下降5%	-339,524.85	-362,905.54

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法



公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价，例如活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，例如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值，例如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	6,903,757.98	6,524,239.60
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	6,903,757.98	6,524,239.60

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本报告期内本基金不存在持有非持续的以公允价值计量的金融工具的情况。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,903,757.98	80.60
	其中：股票	6,903,757.98	80.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,662,125.52	19.40
8	其他各项资产	20.00	0.00
9	合计	8,565,903.50	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,101,057.60	59.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	247,287.00	2.89

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,555,413.38	18.20
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,903,757.98	80.77

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	301030	仕净科技	7,000	483,700.00	5.66
2	605186	健麾信息	9,100	450,450.00	5.27
3	688078	龙软科技	7,500	386,625.00	4.52
4	002698	博实股份	15,200	265,848.00	3.11
5	301236	软通动力	9,200	250,332.00	2.93
6	000034	神州数码	9,300	247,287.00	2.89
7	001223	欧克科技	2,700	245,673.00	2.87
8	688305	科德数控	2,300	230,598.00	2.70

9	603613	国联股份	6,235	230,258.55	2.69
10	688700	东威科技	2,220	221,400.60	2.59
11	002472	双环传动	6,000	217,800.00	2.55
12	688160	步科股份	2,600	217,100.00	2.54
13	000837	秦川机床	13,000	211,640.00	2.48
14	002965	祥鑫科技	3,800	211,584.00	2.48
15	300926	博俊科技	9,000	205,560.00	2.41
16	688232	新点软件	3,800	204,478.00	2.39
17	300496	中科创达	2,000	192,700.00	2.25
18	688628	优利德	3,600	174,924.00	2.05
19	301168	通灵股份	2,700	168,210.00	1.97
20	688596	正帆科技	3,800	164,540.00	1.93
21	600150	中国船舶	4,800	157,968.00	1.85
22	603308	应流股份	8,500	155,550.00	1.82
23	688800	瑞可达	2,500	155,375.00	1.82
24	301191	菲菱科思	1,500	155,130.00	1.81
25	300990	同飞股份	3,060	153,918.00	1.80
26	688579	山大地纬	9,000	148,320.00	1.74
27	300853	申昊科技	4,200	147,420.00	1.72
28	301129	瑞纳智能	2,000	147,340.00	1.72
29	301155	海力风电	1,900	146,452.00	1.71
30	300724	捷佳伟创	1,300	146,055.00	1.71
31	688600	皖仪科技	5,800	143,782.00	1.68
32	688262	国芯科技	3,507	142,699.83	1.67
33	300442	润泽科技	4,000	123,040.00	1.44

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	--------------------

1	300383	光环新网	583,556.00	6.87
2	603985	恒润股份	576,360.00	6.79
3	301236	软通动力	567,232.00	6.68
4	300133	华策影视	547,915.00	6.45
5	300260	新莱应材	546,536.00	6.44
6	301191	菲菱科思	543,775.00	6.40
7	688123	聚辰股份	525,304.00	6.19
8	601111	中国国航	518,700.00	6.11
9	688663	新风光	507,410.11	5.97
10	301030	仕净科技	504,361.00	5.94
11	688596	正帆科技	463,825.00	5.46
12	300926	博俊科技	455,927.00	5.37
13	300118	东方日升	453,663.00	5.34
14	688628	优利德	426,810.00	5.03
15	300925	法本信息	394,199.00	4.64
16	605186	健麾信息	387,829.00	4.57
17	603613	国联股份	383,469.00	4.52
18	300674	宇信科技	347,236.00	4.09
19	002965	祥鑫科技	346,814.00	4.08
20	301168	通灵股份	346,119.00	4.08
21	688401	路维光电	343,950.00	4.05
22	300724	捷佳伟创	336,394.00	3.96
23	002803	吉宏股份	335,770.00	3.95
24	600839	四川长虹	317,535.00	3.74
25	600641	万业企业	314,008.00	3.70
26	300410	正业科技	311,837.00	3.67
27	300990	同飞股份	303,900.00	3.58
28	688262	国芯科技	302,650.00	3.56
29	002472	双环传动	301,920.00	3.56
30	600415	小商品城	301,060.00	3.55
31	603628	清源股份	300,530.00	3.54

32	688158	优刻得	298,050.00	3.51
33	603212	赛伍技术	297,950.00	3.51
34	688078	龙软科技	297,576.92	3.50
35	300659	中孚信息	293,580.00	3.46
36	688313	仕佳光子	293,346.36	3.45
37	002212	天融信	289,080.00	3.40
38	600150	中国船舶	287,700.00	3.39
39	000034	神州数码	278,370.00	3.28
40	603096	新经典	253,884.00	2.99
41	300413	芒果超媒	250,445.00	2.95
42	301278	快可电子	249,940.00	2.94
43	688320	禾川科技	249,394.36	2.94
44	688589	力合微	249,250.77	2.94
45	605286	同力日升	246,650.00	2.90
46	002698	博实股份	244,640.00	2.88
47	300291	百纳千成	236,760.00	2.79
48	002555	三七互娱	234,285.00	2.76
49	001223	欧克科技	215,080.00	2.53
50	300982	苏文电能	211,052.00	2.49
51	300036	超图软件	203,600.00	2.40
52	688305	科德数控	201,842.00	2.38
53	002913	奥士康	200,523.00	2.36
54	002997	瑞鹄模具	199,750.00	2.35
55	688032	禾迈股份	198,394.00	2.34
56	688110	东芯股份	198,106.00	2.33
57	688556	高测股份	196,900.00	2.32
58	300570	太辰光	196,460.00	2.31
59	300785	值得买	196,420.00	2.31
60	603818	曲美家居	195,620.00	2.30
61	301155	海力风电	195,455.00	2.30
62	603916	苏博特	195,074.00	2.30

63	000821	京山轻机	193,523.00	2.28
64	688168	安博通	192,375.00	2.27
65	688232	新点软件	188,190.00	2.22
66	300476	胜宏科技	186,324.00	2.19
67	002518	科士达	186,018.00	2.19
68	300759	康龙化成	183,382.00	2.16
69	300496	中科创达	175,055.00	2.06

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300260	新莱应材	532,835.00	6.27
2	300383	光环新网	516,690.00	6.08
3	603985	恒润股份	516,574.00	6.08
4	688123	聚辰股份	501,014.00	5.90
5	601111	中国国航	490,650.00	5.78
6	300133	华策影视	472,450.00	5.56
7	301191	菲菱科思	469,005.00	5.52
8	688663	新风光	457,901.62	5.39
9	300570	太辰光	445,253.00	5.24
10	688596	正帆科技	428,797.00	5.05
11	002126	银轮股份	423,828.00	4.99
12	300118	东方日升	420,801.00	4.96
13	603076	乐惠国际	416,768.00	4.91
14	002965	祥鑫科技	414,114.00	4.88
15	300925	法本信息	379,920.00	4.47
16	301278	快可电子	372,042.00	4.38
17	688320	禾川科技	367,140.00	4.32
18	600641	万业企业	365,561.00	4.30

19	603305	旭升集团	354,212.00	4.17
20	003043	华亚智能	354,129.00	4.17
21	600415	小商品城	353,300.00	4.16
22	300674	宇信科技	348,697.00	4.11
23	688262	国芯科技	329,878.00	3.88
24	688401	路维光电	328,500.00	3.87
25	688313	仕佳光子	316,520.00	3.73
26	002803	吉宏股份	316,315.00	3.72
27	002212	天融信	299,760.00	3.53
28	301236	软通动力	298,815.00	3.52
29	600839	四川长虹	297,610.00	3.50
30	002850	科达利	295,714.00	3.48
31	300373	扬杰科技	292,979.00	3.45
32	300410	正业科技	292,560.00	3.45
33	300990	同飞股份	289,824.00	3.41
34	603667	五洲新春	288,850.00	3.40
35	688628	优利德	286,892.10	3.38
36	300660	江苏雷利	284,920.00	3.36
37	688158	优刻得	283,253.92	3.34
38	300659	中孚信息	283,080.00	3.33
39	300926	博俊科技	277,384.00	3.27
40	603628	清源股份	265,524.00	3.13
41	603212	赛伍技术	261,426.00	3.08
42	300681	英搏尔	254,760.00	3.00
43	300775	三角防务	251,269.00	2.96
44	688589	力合微	247,909.00	2.92
45	300982	苏文电能	223,920.00	2.64
46	002555	三七互娱	223,472.00	2.63
47	300548	博创科技	218,760.00	2.58
48	605128	上海沿浦	218,600.00	2.57
49	605286	同力日升	217,635.00	2.56



50	300413	芒果超媒	215,569.00	2.54
51	688022	瀚川智能	213,575.00	2.51
52	002120	韵达股份	213,150.00	2.51
53	300036	超图软件	207,810.00	2.45
54	603728	鸣志电器	206,471.00	2.43
55	603096	新经典	203,184.00	2.39
56	300291	百纳千成	196,160.00	2.31
57	300682	朗新科技	192,025.00	2.26
58	301155	海力风电	190,320.00	2.24
59	688032	禾迈股份	190,200.00	2.24
60	603916	苏博特	188,320.00	2.22
61	603818	曲美家居	185,561.00	2.19
62	301030	仕净科技	185,180.00	2.18
63	601636	旗滨集团	184,751.00	2.18
64	000821	京山轻机	183,150.00	2.16
65	688556	高测股份	182,196.00	2.15
66	300724	捷佳伟创	181,444.00	2.14
67	301168	通灵股份	180,960.00	2.13
68	688131	皓元医药	179,250.00	2.11
69	688080	映翰通	176,275.00	2.08
70	001311	多利科技	175,635.00	2.07
71	601689	拓普集团	174,229.00	2.05
72	002997	瑞鹄模具	174,171.00	2.05

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	32,730,818.40
卖出股票收入（成交）总额	32,502,455.96

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

**7.12.2** 本报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20.00

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
瑞达策略优选混合发起A	28	357,880.03	10,000,461.24	99.80%	20,179.58	0.20%
瑞达策略	29	2,017.99	0.00	0.00%	58,521.83	100.00%

优选混合发起C						
合计	54	186,651.16	10,000,461.24	99.22%	78,701.41	0.78%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	瑞达策略优选混合发起A	9,343.40	0.09%
	瑞达策略优选混合发起C	10,010.00	17.10%
	合计	19,353.40	0.19%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	瑞达策略优选混合发起A	0~10
	瑞达策略优选混合发起C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	瑞达策略优选混合发起A	0
	瑞达策略优选混合发起C	0~10

	合计	0~10
--	----	------

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	99.21%	10,000,000.00	99.21%	三年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,000.00	99.21%	10,000,000.00	99.21%	三年

#### §9 开放式基金份额变动

单位：份

	瑞达策略优选混合发起 A	瑞达策略优选混合发起 C
基金合同生效日(2022年05月17日)基金份额总额	10,010,638.84	10,530.00
本报告期期初基金份额总额	10,046,964.64	10,031.26
本报告期基金总申购份额	18,130.91	105,095.80
减：本报告期基金总赎回份额	44,454.73	56,605.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,020,640.82	58,521.83

#### §10 重大事件揭示

##### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人于2023年4月11日公示，宋娴文女士卸任公司职工代表监事职务，由王俊晔先生担任公司职工代表监事职务；刘杨树先生卸任公司独立董事职务，由陈蕾女士担任公司独立董事职务。

2、基金管理人于2023年4月12日公告，宋娴文女士卸任上海分公司负责人职务，由刘冬先生担任上海分公司负责人职务。

3、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、公募基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

招商 证券 股份 有限 公司	2	65,233,274.36	100.0 0%	27,780.08	100.0 0%	-
----------------------------	---	---------------	-------------	-----------	-------------	---

注：（1）基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面。（2）基金交易单元的选择程序如下：1）本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；2）本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。（3）上述佣金包含经手费、证管费和过户费。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	瑞达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	基金管理人网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2023-01-20
2	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金2022年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-01-20
3	瑞达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	基金管理人网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2023-03-31
4	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金2022年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-03-31
5	瑞达基金管理有限公司上海分公司负责人变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站、证券	2023-04-12

		时报、上海证券报、中国证券报	
6	瑞达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	基金管理人网站、证券时报、上海证券报、中国证券报	2023-04-21
7	瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金2023年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-04-21

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023-01-01 至 2023-06-30	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	99.21%

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人巨额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额；
- 3、根据《基金合同》的约定，基金合同生效之日起3年后的对应日（指自然日），若基金资产净值低于2亿元的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时法律法规或监管部门规定发生变化，上述终止规定被取消或更改的，则本基金可以参照届时有效的法律法规或监管部门的规定执行。《基金合同》生效满3年后继续存续的，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召开基金份额持有人大会进行表决。因此，在极端情况下，当单一投资者大量赎回本基金后，可能造成基金资产净值大幅缩减，对本基金的继续存续产生决定性影响；
- 4、其他可能的风险。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录



- 1、中国证监会批准设立瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金的文件
- 2、《瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 7、报告期内瑞达策略优选混合型发起式证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

上海市浦东新区福山路500号城建国际中心2508-2510室

## 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人营业时间免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人，客服电话：400-995-8822，公司网址：[www.ruidaamc.com](http://www.ruidaamc.com)。

瑞达基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日